

臺灣期貨交易所股份有限公司
「臺灣指數公司臺灣上市上櫃生技醫療指數期貨契約」
整戶風險保證金計收方式(SPAN)參數數值

一、價格偵測全距(Price Scan Range, PSR)

PSR=臺灣生技期貨契約結算保證金

二、極端變動倍數(Extreme Move Multiplier)及極端涵蓋百分比
(Extreme Move Covered Fraction)

(一) 極端變動倍數定為 3 倍

(二) 極端涵蓋比率定為 32%

三、波動度偵測全距(Volatility Scan Range, VSR)：不適用。

四、跨月價差風險值(Intra-Commodity Spread Charge)

跨月價差風險值=臺灣生技期貨契約結算保證金×50%

五、跨商品價差折抵率(Inter-Commodity Spread Credit Rate)及契約價
值耗用比率(Delta Per Spread Ratio)

跨商品價差折抵契約	跨商品價差折抵率	契約價值耗用比率
TX vs BT	0.50	1 TX vs 2.63 BT
TE vs BT	0.50	1 TE vs 2.33 BT
TF vs BT	0.50	1 TF vs 1.48 BT
T5 vs BT	0.50	1 T5 vs 4.06 BT
XI vs BT	0.50	1 XI vs 1.35 BT
GT vs BT	0.50	1 GT vs 0.67 BT
G2 vs BT	0.50	1 G2 vs 1.41 BT
E4 vs BT	0.50	1 E4 vs 2.61 BT

六、空方選擇權最低風險值(Short Option Minimum Charge)：不適用。